

Central Daily Market Report

2025年3月26日（水）
セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2025年3月26日 需給速報		2025年3月27日 需給予想		2025年3月28日 当社予想	
銀行券	▲ 200		▲ 600		▲ 500	
財政	▲ 2, 400		11, 700		13, 000	
資金過不足	▲ 2, 600		11, 100		12, 500	
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通						
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入						
国債買入						
CP等買入						
貸出支援基金（成）						
貸出支援基金（貸）						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F 買入						
国債補完供給	▲ 3, 100	4, 100		3, 100		
※ドル資金供給用国債国債供給						
当預増減	▲ 1, 600		14, 200		12, 500	
当座預金残高	5, 265, 700		5, 279, 900		5, 292, 400	
準備預金残高	4, 785, 100					
積み終了先	4, 783, 600				3月27日以降の残り所要積立額	
超過準備	4, 783, 600				積数 9, 600	
非準備預金先	480, 600				1日平均 500	
積み期間（3/16～4/15日）の所要準備額（積数）					4, 121, 700	
準備預金進捗率	実績 99. 77%		日数 35. 48%			

●2025年3月26日の市場動向

＜無担保コール市場＞
本日の無担保コールO/N物は、引き続き邦銀業態からの資金調達ニーズが強く、0.475～0.478%程度での出会いとなった。
ターム物は、証券業態の調達を中心に出会いが見られた。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、0.475～0.49%程度での出会いとなった。
SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

＜短国市場＞
26日のアウトライト市場は動意なく閑散な中、1Y物で出会いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数の業態で発行が実施された。発行レートは0.5%以上で推移し、銘柄により投資家の運用目線にばらつきが見られた。

●短期金融市場関連指標

3/26	無担保コール（速報）							短国	東京レポレート		JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
単位：%	最低	最高	平均		最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値		直近値	前日比	終値	前日比	為替（9時）	為替（17時）
O/N	0.450	0.478	0.477	1W	0.485	0.640	0.577		T+0	0.484	1.580	+0.006	38,027.29	+246.75	149.94-96	150.40-42
T/N				2W					T+1	0.486						
S/N				3W												
2日				1M					1W	0.453						
3日				2M					2W	0.450						
4日			0.630	3M					3W	0.448						
5日				4M					1M	0.447						
6日				5M				3M	0.280	3M	0.461					
有担保コール（速報）				6M				6M	0.400	6M	0.502					
O/N			0.430	1Y				1Y	0.590	1Y	0.604					
日付																
3/18																
3/19																
3/21																
3/24																
3/25																
日銀当預残																
5,147,400																
準備預金残																
4,672,300																
マネタリーベース																
6,381,300																
無担O/N加重平均																
0.476%																
コール市場残高																
120,535																
うち無担																
85,283																
うちO/N																
37,274																
うち有担																
35,252																

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額（億円）	募入額（億円）	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札（億円）	第1非価格競争入札（億円）
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

●オペ結果

種類	オファー額（億円・百万ドル）	スタート日	エンド日	貸付利率	応札総額（億円・百万ドル）	落札総額（億円・百万ドル）	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債補完供給（国債売現先）・即日（午前オファー分）		2025/3/26	2025/3/27	0.250	3,192	3,192		0.250	0.250	
国債補完供給（国債売現先）・即日（午後オファー分）		2025/3/26	2025/3/27	0.250	0	0				

●2025年3月27日の予定

* 10-12月期の米GDP確報値	* 40年利付国債入札（7, 000億円、3/28発行）
-------------------	------------------------------

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂く場合があります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長（登金）第526号 日本証券業協会加入